

УТВЕРЖДАЮ  
Ректор НОУ ВО РЭШ  
А. Д. Суворов  
«27» октября 2023 г.



Негосударственное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Российская экономическая школа» (институт)

**Программа**  
**вступительных испытаний при приеме на обучение по**  
**программе подготовки научных и научно-педагогических**  
**кадров в аспирантуре в 2024 году**

ПРОГРАММА: 5.2.1 Экономическая теория  
ФОРМА ОБУЧЕНИЯ: очная  
СРОК ОБУЧЕНИЯ: 3 года

**(МАКРОЭКОНОМИКА)**

Москва  
2023

# Тема 1. Эконометрика

## 1.1. Введение в эконометрику

Введение: функция условного математического ожидания и наилучший линейный предиктор. Модель простой регрессии. Метод наименьших квадратов.

### Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 1-2.

### Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

## 1.2. Множественный регрессионный анализ

Метрики качества подгонки. Нерелевантные переменные. Смещение вследствие пропущенной переменной. Мультиколлинеарность. Ошибки в спецификации модели. Теорема Гаусса-Маркова. Тестирование гипотез. Доверительные интервалы. Тестирование множественных линейных ограничений. F и t статистики. Состоятельность. Асимптотическая нормальность. Асимптотическая эффективность. Статистика множителя Лагранжа. Качество подгонки и выбор регрессоров. Предсказание. Бинарные переменные. Линейная модель вероятности.

### Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 3-7.

### Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

## 1.3. Гетероскедастичность

Гетероскедастичность. Тестирование на гетероскедастичность. Тест Уайта. Обобщенный метод наименьших квадратов. Статистический вывод, робастный к гетероскедастичности. Ошибка в спецификации функциональной формы. Прокси-переменные. Ошибка измерения. Пропущенные данные.

### Основная литература

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 8-9.

### Дополнительная литература

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

## 1.4. Регрессионный анализ временных рядов

Временные ряды. Стациональность. Предсказание с использованием моделей авторегрессии (AR) и авторегрессионного распределенного лага (ADL). Оценка

динамических причинно-следственных эффектов. Стандартные ошибки, робастные к гетероскедастичности и автокорреляции (HAC).

#### **Основная литература**

Wooldridge, J.M., *Introductory Econometrics: A Modern Approach* (6th edition), South-Western Cengage Learning, 2016, гл. 10-12, 18.

#### **Дополнительная литература**

1) Angrist, J.D., and J.-S. Pischke, *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*, Princeton University Press, 2009.

2) Heiss, F., *Using R for Introductory Econometrics*, <http://www.urfie.net>

## **Тема 2. Микроэкономическая теория**

### **2.1. Теория потребителя**

Отношения предпочтения, существование функции полезности. Функции выбора, многозначные отображения выбора. Слабая аксиома выявленных предпочтений, отношение выявленного предпочтения. Связь между отношениями предпочтения и отображениями выбора. Введение в теорию потребителя: товары, бюджетные множества, функции спроса. Свойства предпочтений, максимизация полезности, спрос по Вальрасу (маршалловский спрос), косвенная функция полезности. Минимизация расходов, спрос по Хиксу (компенсированный спрос), функция расходов. Декомпозиция Слуцкого. Измерение изменений в благосостоянии потребителя: компенсирующая и эквивалентная вариация, потребительский излишек. Рационализуемость потребительского выбора.

#### **Основная литература**

*A.Mas-Collel, M.D.Whinston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995*, главы 1-4.

#### **Дополнительная литература**

1. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.

2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.

3. Rubinstein, A., *Lecture Notes in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 2006.

### **2.2. Выбор в условиях неопределенности и обмен рисками**

Теория ожидаемой полезности: понятие лотереи, составной лотереи, предпочтения на пространстве лотерей, существование функции ожидаемой полезности (фон Неймана - Моргенштерна). Отношение к риску, меры абсолютного и относительного отвращения к риску. Приложения: спрос на страховку и спрос на рисковый актив. Цена информации. Отношения стохастического доминирования первого и второго порядка. Функции полезности, зависящие от состояния мира. Объективная и субъективная неопределенность.

#### **Основная литература**

*A.Mas-Collel, M.D.Whinston, J.R.Green, Microeconomic Theory, New York, Oxford University Press, 1995*, глава 6.

#### **Дополнительная литература**

1. Kreps, D. *A Course in Microeconomic Theory*, Princeton University Press, 1990.

2. Varian H., *Microeconomic Analysis*, 3rd edition. W.W.Norton & Company, New York, London, 1992.

## **Тема 3. Макроэкономика**

### **3.1.1. Введение и учет национального дохода**

Макроэкономические агрегаты. Счета национального дохода. Макроэкономические данные. Равновесие. Национальный доход: источники и использование.

#### **Основная литература**

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 1-3.

#### **Дополнительная литература**

- 1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.
- 2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

### **3.1.2. Деньги, инфляция, финансовая система**

Экономическое определение денег. Количественная теория денег. Предложение денег. Спрос на деньги. Рынок денег. Процентные ставки. Инфляция.

#### **Основная литература**

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 4-5.

#### **Дополнительная литература**

- 1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.
- 2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

### **3.1.3. Открытая экономика: обменные курсы, торговля и потоки капитала**

Платежный баланс. Сбережения и инвестиции в малой открытой экономике. Чистый экспорт. Реальный и номинальный обменные курсы. Паритет покупательской способности. Режимы обменного курса.

#### **Основная литература**

Mankiw, N. Gregory, *Macroeconomics*, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 6.

#### **Дополнительная литература**

- 1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, *Economic Growth*, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.
- 2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., *Financial Markets and Institutions*, 7th edition, Pearson 2012.

### **3.1.4. Экономический рост**

Модель Солоу. Накопление капитала. Уровень капитала, удовлетворяющий “золотому правилу”. Рост населения. Технологический прогресс в модели Солоу. Политика стимулирования роста. Путь сбалансированного роста. Конвергенция. Теория эндогенного роста. Учет роста.

#### **Основная литература**

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 8-9.

**Дополнительная литература**

1) Barro, Robert & Xavier Sala-i-Martin, Economic Growth, 2nd edition, Cambridge MA: MIT Press 2003.

2) Mishkin, Frederic S. & Eakins, Stanley G., Financial Markets and Institutions, 7th edition, Pearson 2012

**3.2.1. Совокупное предложение и совокупный спрос.**

Различные теории совокупного предложения: новая классическая теория и новое кейнсианство. Различия между долгосрочным и краткосрочным периодами.

**Основная литература**

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 10.

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 3.

**3.2.2. Моделирование выпуска в закрытой экономике.**

Модель IS-LM для закрытой экономики и эффекты фискальной и монетарной политик.

**Основная литература**

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 12.

**Дополнительная литература**

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 11-12.

**3.2.3. Моделирование выпуска в открытой экономике.**

Модель IS-LM для открытой экономики с фиксированным и плавающим валютными курсами и эффекты фискальной и монетарной политик.

**Основная литература**

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 13-14.

**Дополнительная литература**

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 13.

**3.2.4. Инфляция, инфляционный налог и сеньораж.**

Государственный бюджет, рост денежной массы и инфляция, дефицит государственного бюджета.

**Основная литература**

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 9, 11.

**3.2.5. Инфляция и безработица.**

Экономическая политика и кривая Филипса.

**Основная литература**

Jeffrey D. Sachs, Felipe Larrain B., Macroeconomics in the Global Economy, Prentice-Hall, Inc., 1993, гл. 15.

**Дополнительная литература**

Mankiw, N. Gregory, Macroeconomics, 8th edition, Worth Publishers 2012, гл. 14.

**3.3.1. Модель Солоу в непрерывном времени**

Основные принципы построения моделей в непрерывном времени, фазовые диаграммы, модель с человеческим капиталом.

**Основная литература**

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter

2, 10.3.

### **3.3.2. Неоклассическая модель роста.**

Решение задачи планировщика, сбалансированная траектория роста, децентрализованное равновесие.

#### **Основная литература**

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter 8.

### **3.3.3. Модель перекрывающихся поколений**

Рост в модели перекрывающихся поколений, динамическая неэффективность, деньги и пузыри.

#### **Основная литература**

Acemoglu, Daron, Introduction to modern economic growth, Princeton Univ. Press, 2009, chapter 9.

#### **Дополнительная литература**

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press, chapters 3-5.

### **3.4.1. Потребление.**

Теория жизненного цикла и гипотеза постоянного дохода. Потребление в условиях неопределенности: гипотеза случайного блуждания. Эмпирические приложения: избыточная гладкость и избыточная чувствительность потребления. Расширения: сбережения по мотивам предосторожности, ограничения заимствования (ликвидности), формирование привычек, товары длительного пользования, динамически несостоятельные предпочтения.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 5th ed. – гл. 8

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press – гл. 6.2

#### **Дополнительная литература**

Attanasio, Orazio P., Consumption, in J.B. Taylor & M. Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

Attanasio & Weber, Consumption and Saving: Models of Intertemporal Allocation and Their Implications for Public Policy, JEL 48, 2010

Browning & Crossley, The Life-Cycle Model of Consumption and Saving, JEP 15-3, 2001

Carroll, A Theory of the Consumption Function, with and without Liquidity Constraints, JEP 15-3, 2001

### **3.4.2. Ценообразование активов**

SAPM и CAPM на основе потребления. Модель ценообразования активов Лукаса. Временная структура процентных ставок. Цены акций и загадка премии за риск.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), Advanced Macroeconomics, McGraw-Hill Irwin, 4th ed. – гл.8

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), Lectures on Macroeconomics, MIT Press – гл. 10.1

#### **Дополнительная литература**

Campbell, John Y., Asset Prices, Consumption and the Business Cycle, in J.B. Taylor & M.

Ljungqvist, Lars & Sargent, Thomas J., Recursive Macroeconomic Theory, The MIT Press, 2nd ed., 2004 – гл. 13

Woodford (eds.), Handbook of Macroeconomics, Elsevier Science, 1999

### **3.4.3. Инвестиции.**

Модель инвестиций с издержками приспособления, модель q-Тобина, её эмпирическое тестирование, условия Хаяши. Теорема Модильяни-Миллера. Расширения: невыпуклые издержки приспособления, фиксированные издержки приспособления. Инвестиции в

условиях неопределенности, невозвратные инвестиции и реальные опционы.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 4th ed. – гл.9

Blanchard, O.J., and S. Fischer (1989), *Lectures on Macroeconomics*, MIT Press – гл. 6.3

#### **Дополнительная литература**

Caballero, Ricardo J., *Aggregate Investment*, in J.B. Taylor & M. Woodford (eds.), *Handbook of Macroeconomics*, Elsevier Science, 1999

### **3.5.1. Основные эмпирические факты о деловых циклах.**

Тренд и деловой цикл: как их различать на практике? Циклическое поведение основных макроэкономических временных рядов.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable – гл. 5.1 – 5.2

Uribe, M., and S. Schmitt-Grohé, M. (2017), *Open Economy Macroeconomics*, Princeton University Press, chapter 1

#### **Дополнительная литература**

Stock, J., and M. Watson (1999), “Business Cycle Fluctuations in U.S. Macroeconomic Time Series”, Chapter 1, Volume 1A, *Handbook of Macroeconomics*, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, pp. 3-64

Ng, S., and J.H. Wright (2013), “Facts and Challenges from the Great Recession for Forecasting and Economic Modeling,” *Journal of Economic Literature* 51(4), 1120-1154

Stock, J.H., and M.W. Watson (2001), “Vector Autoregressions,” *Journal of Economic Perspectives* 15(4), 101-115

Ramey, V.A. (2016), “Macroeconomic Shocks and Their Propagation,” in *Handbook of Macroeconomics*, Volume 2A, Elsevier B.V.

Nakamura, E., and J. Steinsson (2018), “Identification in Macroeconomics,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 59-86

### **3.5.2. Теория реальных деловых циклов.**

Шоки производительности как потенциальная движущая сила делового цикла.

Аналитически решаемая версия модели реальных деловых циклов. Решение лог-линеаризованной РДЦ модели в общем случае, импульсные отклики. Калибровка модели на данных и ограничения РДЦ модели.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable – гл. 5.3 – 5.10

#### **Дополнительная литература**

King, R., and S. Rebelo (1999), “Resuscitating Real Business Cycles”, Chapter 14, Volume 1B, *Handbook of Macroeconomics*, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, 927-1007

Prescott, E.C. (2016), “RBC Methodology and the Development of Aggregate Economic Theory” in *Handbook of Macroeconomics*, Volume 2B, Elsevier B.V.

Kehoe, P.J., V. Midrigan, and E. Pastorino (2018), “Evolution of Modern Business Cycle Models: Accounting for the Great Recession,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 141-166

### **3.5.3. Несовременная информация и реальные эффекты денег.**

Свидетельства отсутствия нейтральности денег в краткосрочной перспективе.

Несовременная информация о шоках совокупного спроса как возможная причина отсутствия нейтральности денег. Модель несовершенной информации Лукаса.

Стратегическая комплементарность и неполное подстраивание под новую информацию.

Калибровка монетарных моделей деловых циклов с несовершенной информацией.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable – гл.6

#### **Дополнительная литература**

Angeletos, G.-M., and C. Lian (2016), “Incomplete Information in Macroeconomics: Accommodating Frictions in Coordination,” in *Handbook of Macroeconomics*, Volume 2A, Elsevier B.V.

### **3.5.4. Новое Кейнсианство (НКЕ).**

Макро- и микроэкономические свидетельства жёсткости цен на товары и зарплат. Издержки меню как причина номинальных жёсткостей. Реальные жёсткости и стратегическая комплементарность. Модели жестких цен, основанные на времени (time-dependent) и на состояниях (state-dependent). Ново-Кейнсианская кривая Филлипса: вывод и калибровка. Неразрешенные проблемы НКЕ моделей.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 5th ed.; earlier editions are also acceptable – гл.7

#### **Дополнительная литература**

Taylor, J.B., “The Staying Power of Staggered Wage and Price Setting Models in Macroeconomics,” in *Handbook of Macroeconomics*, Volume 2B, Elsevier B.V.

Walsh, C.E., *Monetary Theory and Policy*, MIT Press, 4th ed., 2017

Galí, J., *Monetary Policy, Inflation, and the Business Cycle*, Princeton University Press, 2nd ed., 2015

Galí, J. (2018), “The State of New Keynesian Economics: A Partial Assessment,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 87-112

Christiano, L.J., M.S. Eichenbaum, and M. Trabandt (2018), “On DSGE Models,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 113-140

Kaplan, G., and G.L. Violante (2018), “Microeconomic Heterogeneity and Macroeconomic Shocks,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 167-194

### **3.5.5. Несовершенства на рынках благ и факторов производства.**

Рыночные несовершенства как возможный источник реальных жёсткостей. Издержки поиска на рынке труда и их последствия. Несимметричная информация на финансовых рынках и распространение шоков.

#### **Основная литература**

Romer, D. (2019), *Advanced Macroeconomics*, McGraw-Hill Irwin, 4th ed.; earlier editions are also acceptable – гл.10

#### **Дополнительная литература**

Mortensen, D.T., and C.A. Pissarides (1999), “Job Reallocation, Employment Fluctuations, and Unemployment,” Chapter 18, Volume 1B, *Handbook of Macroeconomics*, J. Taylor and M. Woodford eds, North Holland, 1171-1228

Pissarides, C.A. (2000), *Equilibrium Unemployment Theory*, 2nd edition, MIT Press

Shimer, R. (2010), *Labor Markets and Business Cycles*, Princeton University Press

Brunnermeier, M.K., T.M. Eisenbach, and Y. Sannikov (2013), “Macroeconomics with Financial Frictions: A Survey,” in D. Acemoglu, M. Arellano and E. Dekel (eds.), *Advances in Economics and Econometrics*, Tenth World Congress of the Econometric Society, Vol. II: Applied Economics, Cambridge University Press, New York, 4-94

### **3.5.6. Финансовый кризис 2007-2009 и состояние макроэкономики.**

Как Великая Рецессия повлияла на современное макроэкономическое моделирование и мышление?

#### **Основная литература**

Gertler, M., and S. Gilchrist (2018), “What Happened: Financial Factors in the Great Recession,” *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 3-30



Mian, A., and A. Sufi (2018), "Finance and Business Cycles: The Credit-Driven Household Demand Channel," *Journal of Economic Perspectives* 32(3), 31-58